



Backtest #47731 · TRUMP/USD · TRUMP/USD · TS-Momentum Crypto (24/7) (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
-9.90%	-1.72	0.0%	-9.90%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

El backtest de TRUMP/USD con la estrategia de momentum TS-Momentum muestra una ineficacia total, registrando un ROI negativo del 9.90% y una tasa de ganancia del 0% en solo dos operaciones. La relación de Sharpe de -1.72 indica un rendimiento sistemáticamente inferior al de mantener el capital en efectivo, mientras que la pérdida máxima del 10% confirma una exposición de riesgo desproporcionada. Con una muestra tan pequeña de dos operaciones, cualquier conclusión estadística carece de poder significativo y no valida la viabilidad de la estrategia en este par específico. El único resultado útil es que el filtro de entrada actual falla completamente en detectar movimientos favorables en este activo volátil. Se requiere reanudar la simulación con

ADDITIONAL METRICS

CAGR	-9.90%
Sortino Ratio	-0.31
Turnover	3.83x
Total Trades	2
Initial Capital	\$10000.00
Final Capital	\$9009.95